

# Central Daily Market Report

2023年10月6日(金)  
セントラル短資株式会社 総合企画部

## ●資金需給

単位: 億円	2023年10月6日 需給速報	2023年10月10日 需給予想	2023年10月11日 当社予想			
銀行券	0	200	▲ 1,000			
財政	▲ 12,300	▲ 1,900	3,000			
資金過不足	▲ 12,300	▲ 1,700	2,000			
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通			10,000			▲ 8,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 600	▲ 100			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 40,100	41,900	40,100			
当預増減	▲ 11,100	48,300	▲ 6,500			
当座預金残高	5,380,700	5,429,000	5,422,500			
準備預金残高	4,714,600					
積み終了先	4,714,600			10月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,714,400			積数	400	
非準備預金先	666,100			1日平均	100	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,887,300	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	80.00%		

## ●2023年10月6日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.05~▲0.005%近辺の出合いが始まった。引き続き資金調達ニーズが強いなか、週末4日積みの取引となった事から、朝方は高めのレート水準での出合いが多く見られた。一巡後はビッドが減少するなか、レート水準はやや低下し、▲0.03%近辺での出合いが中心となった。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.115~▲0.095%程度での出合いとなった。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

### <短国市場>

6日はTB3M物(第1187回)の入札が実施され、やや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2023/10/6	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.087	▲ 0.003	▲ 0.016				-	▲ 0.098	0.798	▲ 0.002	30,994.67	▲ 80.69	148.47-49	148.88-90
T/N							-	▲ 0.103						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.031				-	▲ 0.146						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.164						
3W							-	▲ 0.168						
1M	▲ 0.010	0.250	0.120				-	▲ 0.179						
3M							▲ 0.201	▲ 0.200						
6M							▲ 0.171	▲ 0.127						
1Y							▲ 0.095	▲ 0.087						
									日付	9/29	10/2	10/3	10/4	10/5
									日銀当預残	5,472,000	5,455,200	5,441,600	5,372,200	5,391,800
									準備預金残	4,799,300	4,760,000	4,732,000	4,693,000	4,708,700
									マネタリーベース	6,726,100	6,708,900	6,695,200	6,625,800	6,645,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.062%	▲ 0.044%	▲ 0.031%	▲ 0.021%	▲ 0.015%
									コール市場残高	142,574	185,184	203,125	212,513	207,889
									うち無担	122,880	158,378	175,480	185,815	181,595
									うちO/N	77,037	93,240	104,632	114,212	108,587
									うち有担	19,694	26,806	27,645	26,698	26,294

## ●入札結果

名称	国号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1187	-	56,000	2023/10/10	2024/1/15	130,758.9	45,390.7	100.0520	▲0.1955%	68.8260%	100.0579	▲0.2177%	10,609

## ●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率*	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/10/10		0.200	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/10/10		0.410	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/10/6	2023/10/10	▲0.350	40,928	40,928		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店) <金利入札方式>	10,000	2023/10/10	2028/10/10		34,190	10,006	0.250		0.288	5.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/10/6	2023/10/10	▲0.350	0	0				

\*オペの種類が、国債補充供給(国債売現先)の場合は、上限期間利回り、国債買入(固定利回り方式)の場合は、固定利回較差。

※1固定利回較差の結果、10年利付国債372回の買入利回りは、1.000%となる。買入金額に制限を設けずオファー。※2固定利回較差の結果、10年利付国債361回の買入利回りは、1.000%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

## ●2023年10月9日の予定

*スポーツの日	*New York祝日(Columbus Day)
---------	---------------------------

## ●2023年10月10日の予定

*8月の国際収支 *8月の特定サービス産業動態統計速報 *9月の景気ウォッチャー調査	*8月の米卸売上高
--	-----------

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入